

GBMfondos

GBMPAT GBM FONDO PATRIMONIAL, S.A. DE C.V., F.I.I.D.
CARTERA DE VALORES AL 28 JUNIO, 2024

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
DIRECTO						
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL BONDES F						
LF	BONDES F	261203	mxAAA	1,000,000	99,974,497.00	2.52
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL CON TASA DE INTERÉS FIJA						
M	BONOS	260305	mxAAA	4,200,000	396,466,366.80	10.00
M	BONOS	240905	mxAAA	2,000,000	203,973,946.00	5.15
BONOS DE DESARROLLO DEL GOBIERNO FEDERAL EN UDIS SEGREGABLES						
S	UDIBONO	251204	mxAAA	447,975	354,854,912.50	8.95
CERTIFICADOS BURSÁTILES BANCARIOS						
94	BINBUR	14-7	mxAAA	950,000	96,683,833.20	2.44
CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
91	BBVALMX	18-2	AAA(mex)	1,020,000	104,824,136.22	2.65
OTROS TIPO DE VALOR 91 - CERTIFICADOS BURSÁTILES DE EMPRESAS PRIVADAS						
				8,684,926	889,578,203.07	22.45
CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
				1,674,765	160,812,108.22	4.06
OTROS TIPO DE VALOR 95 - CERTIFICADOS BURSÁTILES EMITIDOS POR ENTIDADES O INSTITUCIONES DEL GOBIERNO FEDERAL						
CERTIFICADOS DE LA TESORERÍA DE LA FEDERACIÓN CON IMPUESTO						
BI	CETES	250320	mxAAA	20,000,000	184,924,980.00	4.67
BI	CETES	241003	mxAAA	18,500,000	179,766,294.50	4.54
EUROBONOS DE EMPRESAS PRIVADAS						
D2	BAC847	250216	A-	1,000	103,857,620.22	2.62
TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
J1	CABEI	1-23S	mxAAA	1,030,000	104,028,873.18	2.63
				821,169	82,664,995.97	2.09
OTROS TIPO DE VALOR J1 - TÍTULOS DE DEUDA DE ORGANISMOS FINANCIEROS MULTILATERALES						
TÍTULOS DE DEUDA EMISORAS EXTRANJERAS SIC						
D8	MSF0925	FLOAT	A-	39	98,035,739.14	2.47
D8	CIT1125	FLOAT	A	34	85,952,752.77	2.17
				3,509	88,685,363.34	2.24
TOTAL INVERSIONES EN DIRECTO					3,235,084,622.13	81.63
REPORTO						
LF	BONDES F	251002	mxAAA	1,882,645	188,822,140.30	4.76
LF	BONDES F	270318	mxAAA	1,630,246	162,895,822.96	4.11
TOTAL REPORTO					351,717,963.26	8.88
OTROS VALORES				27,425,142	376,193,502.37	9.49
TOTAL DE INVERSIONES EN VALORES					3,962,996,087.76	100.00

CATEGORÍA IDDIS

CALIFICACIÓN
AAAf/S4(mex)

VaR Promedio
0.039%

Límite de VaR
0.690%

Para llevar a cabo la estimación del Valor en Riesgo (VaR) de mercado para las Fondos de Inversión administrados por Operadora GBM, se acordó con la empresa Valor de Mercado (Valmer) que sea ella quien lo realice, siguiendo los criterios metodológicos aprobados por la Unidad de Administración Integral de riesgos de la Operadora.

El método utilizado para la estimación del VaR es el conocido como simulación histórica, con los parámetros que se presentan a continuación:

- Un periodo de muestra de un año
- El nivel de confianza para el VaR fijado al 95%
- El horizonte temporal para el que se estime la posible minusvalía será de 1 día